

中证中信证券 0-1 年 AAA 公司债指数编制方案

中证中信证券 0-1 年 AAA 公司债指数的样本券由在上海证券交易所上市的、债项评级 AAA 且中证估值隐含评级 AA+以上、剩余期限在 1 年及以下的公司债组成，指数采用市值加权计算。

一、指数名称和代码

指数名称：中证中信证券 0-1 年 AAA 公司债指数

指数简称：中证中信证券 0-1AAA 公司债

英文名称：CSI CITIC Securities 0-1Y AAA Corporate Bond Index

英文简称：CSI CITIC Securities 0-1 AAA Corporate Bond

指数代码：931388

二、指数基日和基点

该指数以 2015 年 12 月 31 日为基日，以 100 点为基点。

三、样本选取方法

中证中信证券 0-1 年 AAA 公司债指数的样本由满足以下条件的债券构成：

(1) 债券种类：在上海证券交易所上市的公司债，不含永续债、含权债，债券币种为人民币；

(2) 债券剩余期限：1 年及以下；

(3) 信用评级：债项评级 AAA，且中证估值隐含评级 AA+以上；

(4) 付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

四、指数计算

中证中信证券 0-1 年 AAA 公司债指数采用派许加权综合价格指数方法计算，计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本债券总市值} + \text{报告期债券派息}}{\text{除数}} \times 100$$

其中，报告期样本债券总市值 = \sum (全价 \times 发行量)，全价=净价+应计利息。

该指数计算用价格为中证估值价格，其他计算用基础数据、除数调整参见计算与维护细则。

五、样本调整

1、定期调整

中证中信证券 0-1 年 AAA 公司债指数样本每月调整一次，定期调整生效日为每月首个交易日，定期调整数据提取日为生效日前第二个交易日。

2、临时调整

若样本券发生暂停上市、摘牌等事件，视情况自事件生效之日起剔除出指数；样本券发生其他事件，参照计算与维护细则处理。